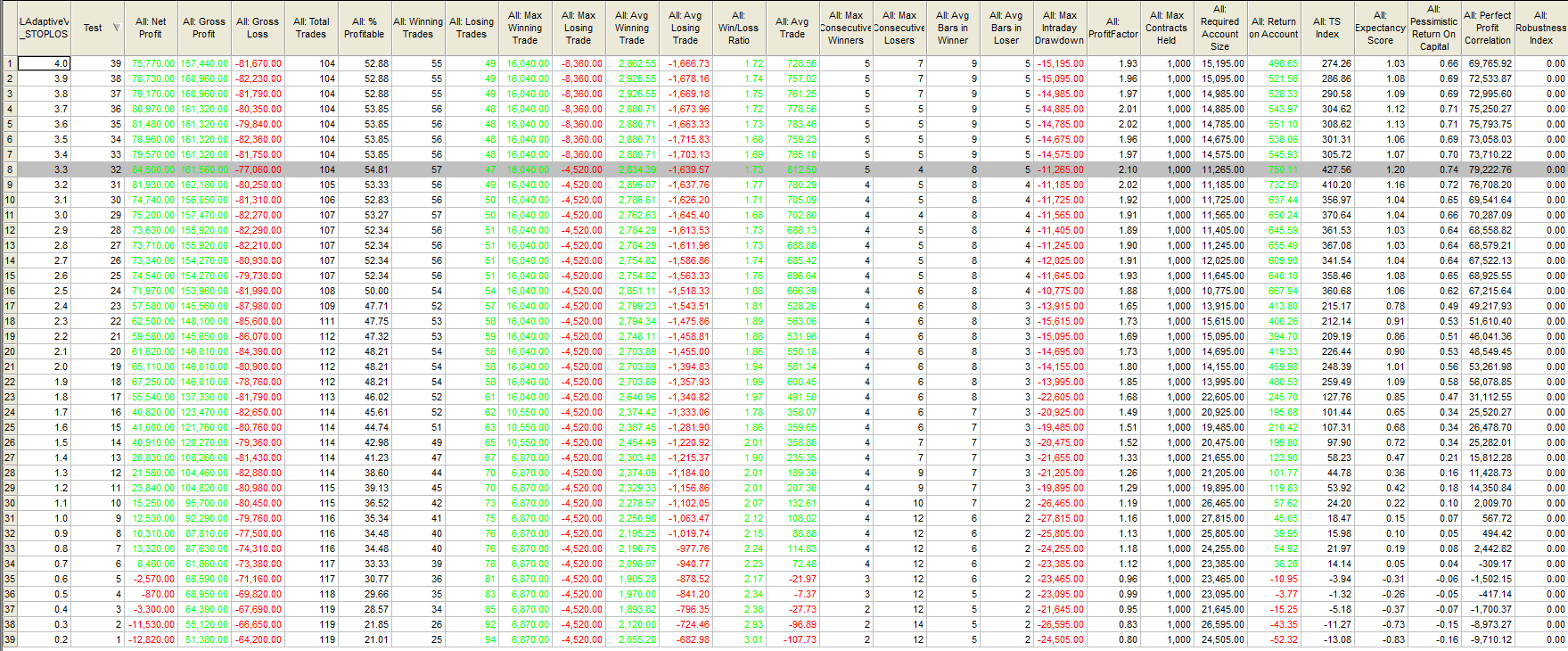
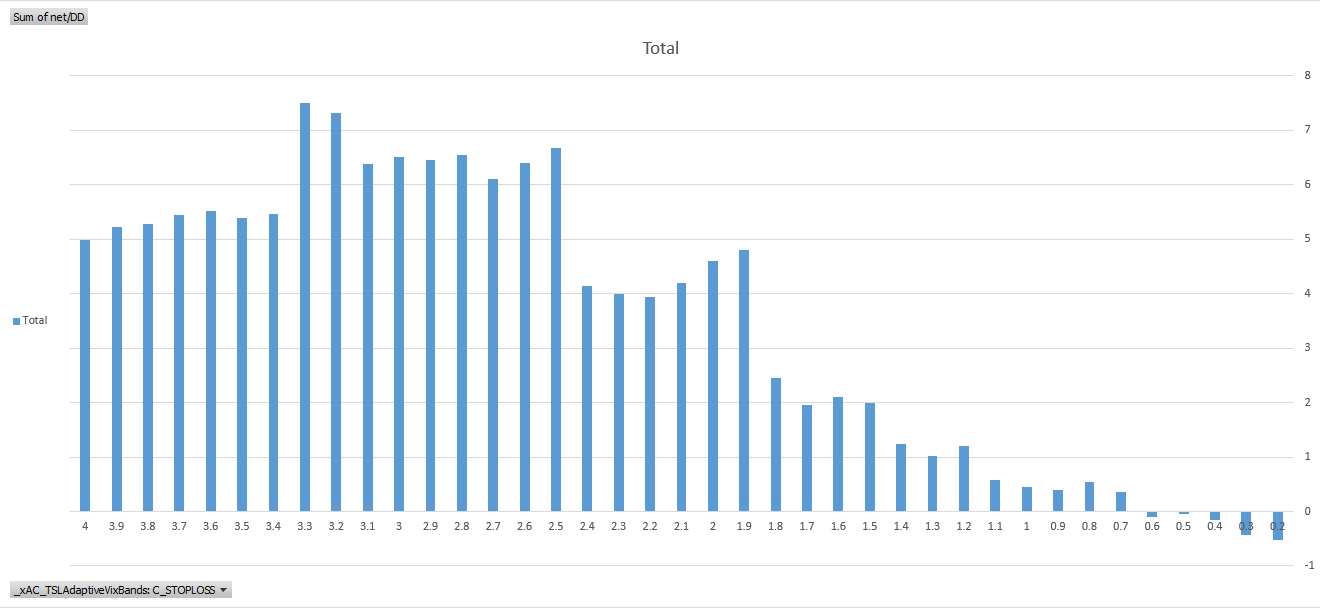
* עשינו בדיקת פרמטרים מ0.2 עד 4 בקפיצות של 0.1



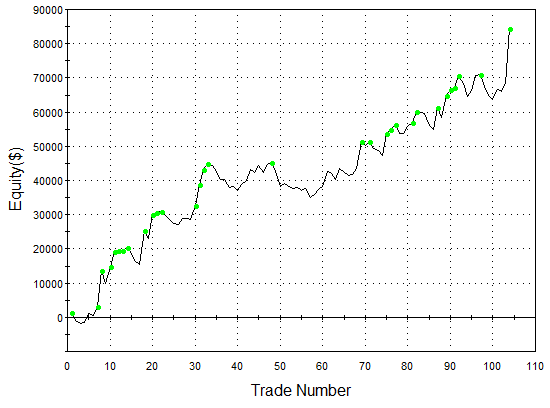
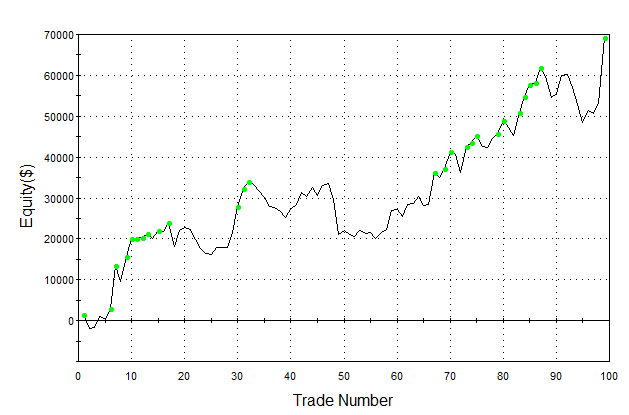
* הגרף שלNetProfit/MaxDrawdown ביחס לאחוז ה.StopLos (כפלנו במינוס 1, הגרף נמצא באקסל)



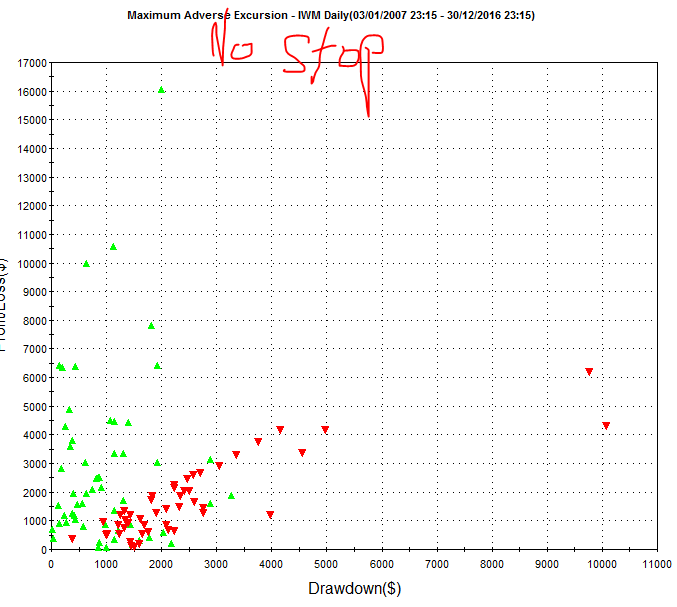
* הפרמטר הכי טוב בגרף הוא 3.3 (שני הדוחות המלאים – בלי סטופ לוס ועם 3.3% נמצאים באקסל).

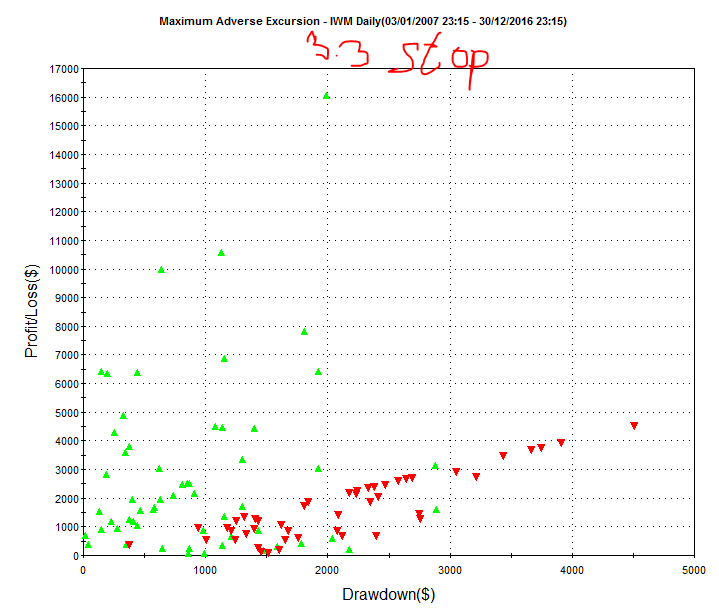
|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| No stop | Stop 3.3% |  |
| 79220$ | 84500$ | Total Net Profit |
| 2% | 2.1% | Profit Factor |
| 104 | 104 | Total Number of Trades |
| 73 | 73 | Long Trades |
| 31 | 31 | Short Trades |
| 53.85% | 54.81% | Percent Profitable |
| 56 | 57 | Winning Trades |
| 79.22% | 84.5% | Return on Initial Capital |
| 6.08% | 6.39 | Annual Rate of Return |
| 151 | 199.44 | RINA Index |
| 26.12% | 24.46% | Percent of Time in the Market |
| -16120 | -13630$ | Max. Drawdown (Intra-day Peak to Valley) |
| 16.12% | 13.63% | as % of Initial Capital |
| 491.44% | 619.96% | Net Profit as % of Drawdown |
| 13640$ | 10290$ | Account Size Required |

השוואה בין גרפי ה Equity, עם סטופ 3.3% משמאל ובלי מימין:



* שוב, הגרפים מאוד דומים אך ניתן לראות "התכווצות" בגרף משמאל. התכווצות זו כתוצאה מהסטופ לוס. בסעיף B קיצרנו לו את היכולת להבחין בתחילת מגמה שלילית לנו ואפשרנו לו לברוח בפחות ברים. עכשיו אמרנו לו שהוא יכול לברוח אם ירדנו 3.3% בלי קשר לברים. לכן נותרנו פחות חשופים לא רק בשינוי מגמה אלא גם בשינוי חד. השינוי הכי גדול ומשמעותי שעשינו הוא מזעור הDRAWDOWN שלנו. קיבנו כמעט אותה תשואה (חמשת אלפים יותר) אבל מזערנו משמעותית את הסיכון שלנו מ16 אלף ירדנו ל13 אלף. כתוצאה מכך גודל החשבון ירד גם כן משמעותית, אחוזי הNETPROFIT ביחס לDRAWDOWN גדלו ב150%, RINA אינדקס טיפס מ151 ל200.





* צריך לנסח את התשובה לסעיף 3 C
* מיכאל: לא כל כך הבנתי את השאלה. אני חושב שזו השאלה שפעם הוא אמר לחשוב בבית. השאלה הייתה איך יכול להיות שאנחנו רואים הפסדים גדולים יותר מהסטופ לוס שהגדרנו.

מזכרוני התשובה היא :

* אנחנו על גרף דיילי, כלומר חשופים לתנועות PRE AND POST מסחר.